



Profuturo®

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO FONDO PROFUTURO SB4, S.A. DE C.V., SIEFORE, SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO

TIPO DE SIEFORE: Básica 1 () Básica 2 () Básica 3 () Básica 4 (x) Básica de Pensiones () Corto Plazo () Largo Plazo () Previsión Social ()

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA AL 31 DE MARZO DE:

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2017	2016	PASIVO	2017	2016
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	1,360,294	2,177,468	Divisas por entregar	25,841	226,138
Bancos monedas extranjeras	821,884	873,811	Acreedores	877,203	356,619
	<u>2,182,178</u>	<u>3,051,279</u>	Provisiones para gastos	6,189	2,091
RESERVADOS					
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en MN	490,578	-			
	<u>490,578</u>	<u>-</u>			
INVERSIONES			TOTAL PASIVO	909,234	584,848
Inversión en valores de renta variable	11,586,251	13,931,295			
Plus (Minus) valías en Valores de Renta Variable	2,900,086	1,908,824			
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS	19,539,731	19,031,416			
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y UDIS	4,327,863	4,012,435			
Inversión en Instrumentos de Deuda Nacional de Tasa Nominal Denominados en Pesos	25,831,852	20,547,831	CAPITAL CONTABLE		
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	-415,391	4,584	CAPITAL		
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	297,420	352,481	Capital contribuido	36,303,607	39,978,698
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	92,739	63,412	Capital social pagado	36,019,546	38,548,476
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,043,155	1,933,869	Prima en venta de acciones	284,061	1,430,222
Plus (Minus) valía en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	-8,308	49,353			
Inversión en Fibras	659,860	894,941	Capital ganado	29,069,039	24,534,538
Plus (Minus) valía en Inversión en Fibras	-85,797	-7,777	Resultados de ejercicios anteriores	27,904,153	24,470,409
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	483,861	706,636	Resultado del ejercicio	1,164,886	64,129
Inversión en Valores Extranjeros de Deuda	845,185	1,024,894			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	80,773	135,547			
Inversión en Títulos Fiduciarios	2,682,576	2,546,006			
Plus (Minus) valía en Títulos Fiduciarios	788,536	544,533			
Valores Prestados	-	81,337			
Plus (Minus) valía de valores prestados	-	1,982	Otros Resultados Integrales		
	<u>70,640,792</u>	<u>67,759,034</u>			
DEUDORES DIVERSOS			Plus (Minus) valías	7,670,501	6,708,429
Liquidadora	200,294	564,582			
Dividendos o derechos por cobrar	2,456	801			
Intereses devengados sobre valores	436,082	429,159			
Premios por cobrar por préstamo de valores	-	1			
Intereses devengados sobre valores prestados	638,832	1,657			
		<u>996,200</u>			
TOTAL ACTIVO	73,952,380	71,806,513	TOTAL CAPITAL CONTABLE	73,043,146	71,221,665
			TOTAL PASIVO Y CAPITAL	73,952,380	71,806,513

CUENTAS DE ORDEN

Valores entregados en custodia	70,156,931	66,973,043	Capital social autorizado	1,000,000,100	1,000,000,100
Valores Prestados	-	79,353	Acciones emitidas	208,233,011,885	208,233,011,885
Garantías recibidas por valores prestados	-	84,745	Acciones en circulación posición propia	54,593,875	59,522,692
Bancos divisas en moneda extranjera	43,775	50,774	Acciones de Siefores, Posición de Terceros	-	1
Dólares americanos	13,564	50,421	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	7,445,863,907	7,967,541,758
Otras Divisas	191	352			
Dólar canadiense	181	352			
Divisas por entregar	1,375	13,119			
Dólares americanos	1,375	13,119			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	2,744,414	2,534,874			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga	11,960,585	11,943,755			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	1,477,861	9,218,203			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	7,751,342	18,180,899			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	352,381	348,533			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	2,379,000	2,379,000			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta	13,692,608	18,180,899			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	2,250,350	3,380,355			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	2,725,174	3,853,909			
Contratos Futuros sobre Euros	4,635,425	4,948,380			
Contratos Futuros sobre Yenes	485,896	1,439,112			
Contratos Futuros sobre Otras Divisas	1,027,083	2,180,142			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	2,379,000	2,379,000			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:					
Un valor de los activos netos de:	\$ 7,670,501	\$ 6,708,429			
El precio de la acción de:	\$ 73,043,146	\$ 71,221,665			
	\$ 9,738,492	\$ 8,872,691			

MARTHA BARRERA FERNÁNDEZ

Contador General SIEFORE

Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

ARTURO GARCÍA RODRÍGUEZ

Director General

Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

Los presentes estados financieros han sido formulados de acuerdo a las reglas de agrupación de cuentas establecidas por la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro y bajo la estricta responsabilidad de los funcionarios que suscriben. Los presentes estados financieros fueron aprobados por el consejo de administración de fecha 24 de abril de 2017

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO FONDO PROFUTURO SB4, S.A. DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO

TIPO DE SIEFORE: Básica 1 () Básica 2 () Básica 3 () Básica 4 (x) Básica de Pensiones () Corto Plazo () Largo Plazo () Previsión Social ()

ESTADO DE RESULTADOS INTEGRAL

(Cifras en miles de pesos)

Por los periodos al 31 de Marzo de:

	2017	2016
Ingresos por la venta de Valores	4,973,885	6,450,510
Intereses, dividendos, premios y derechos	624,107	572,641
Resultado cambiario / Otros productos	-137,977	-33,405
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	813,333	-435,622
Ingresos Netos	6,273,348	6,554,124
Costo de ventas de valores	4,922,755	6,306,924
Gastos generales	181,425	6,525
Comisiones sobre saldos	181,425	176,546
Egresos netos	5,108,463	6,489,996
Utilidad de operación	1,164,886	64,129
Otros Resultados Integrales		
Plus (Minus) Valías	1,101,496	998,549
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	2,266,382	1,062,678

MARTHA BARRERA FERNÁNDEZ

Contador General SIEFORE

Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

ARTURO GARCÍA RODRÍGUEZ

Director General

Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

El presente estado financiero se formuló de conformidad con las reglas de agrupación de cuentas establecidas por la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro y bajo la estricta responsabilidad de los funcionarios que suscriben. Los presentes estados financieros fueron aprobados por el consejo de administración de fecha 24 de abril de 2017